



Swiss Life Funds (F) Equity ESG Europe Minimum Volatility D

NAV des Fonds: 191.98 Mio. EUR | NAV je Anteil: 172.77 EUR



SFDR Offenlegung: Artikel 8

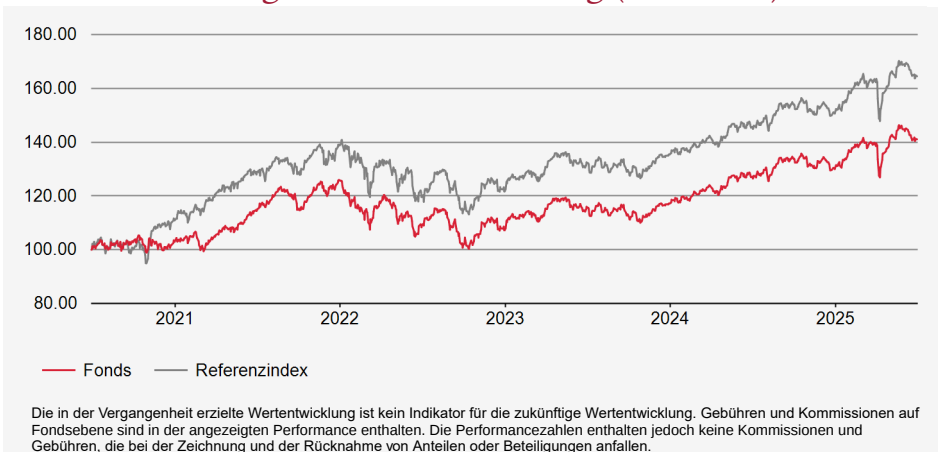
Management Kommentar

Der europäische Markt ging im Juni zurück, v. a. in den sogenannten defensiven Sektoren wie Basiskonsumgüter und Gesundheitswesen. Die Outperformance ist primär auf die Titelauswahl in den Sektoren Energie und Grundstoffe zurückzuführen. Das Untergewicht des Energiesektors wirkte sich hingegen leicht negativ auf die Strategie aus. Der Nachhaltigkeitsfokus des Fonds war während des Monats neutral.

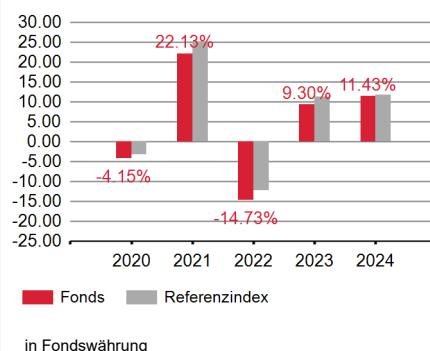
Anlagestrategie

Der Fonds investiert über eine quantitative MinVar-Strategie in europäische Aktien primär von grossen und mittleren Unternehmen. Dabei wird jeden Monat aus den Titeln des Universums das am wenigsten volatile Portfolio identifiziert. Das Portfolio wird mit einem internen Optimierungsmodell konstruiert.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Performance



Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance						Annualisierte Performance		
	YTD	1 Monat	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	Aufl.	3 Jahre	5 Jahre	Aufl.
Fonds	8.03%	-	11.10%	30.20%	41.05%	66.02%	9.19%	7.12%	1.88%
Ref. Index	8.74%	-	13.16%	37.55%	64.48%	207.69%	11.20%	10.46%	4.22%

Risikoindikatoren

Geringes Risiko < 1 2 3 4 5 6 7 > Hohes Risiko
Potenziell niedrigere Wertentwicklung Potenziell höhere Wertentwicklung

Max. Drawdown

-20.35%

Recovery

575 Tage

Beta

0.99

Alpha

-0.03

Wöchentlich annualisiert

	1 Jahr	3 Jahre	Aufl.
Volatilität Portfolio	10.72%	10.71%	17.15%
Volatilität Ref. Index	10.78%	10.81%	19.91%
Tracking Error	1.28	1.68	7.09
Information Ratio	-1.68	-1.02	-0.33
Sharpe Ratio	0.72	0.55	0.02

Fondseigenschaften

Auflagedatum: 21/04/1998

ISIN: FR0010074922

Bloomberg-Code: SLFAEUD FP

Morningstar Kategorie: Aktien Europa
Standardwerte Blend

Fondswährung: EUR

Fondsdomizil: Frankreich

Ref. Index: MSCI Europe Min. Volatility Opt
in Euro Net Local

Mindestanlage: 0.01 Anteile

Zeichnungsgebühren (max.): 3.00%

Rücknahmekommission (max.): 0.00%

Verwaltungsgebühren: 1.75%

Performancegebühren: Keine

Laufende Kosten per 31/12/2024: 1.78%

Zeichnung / Rückzahlung: Orderschluss
15:00 Abwicklung T+2

Ertragsverwendung: Ausschüttung

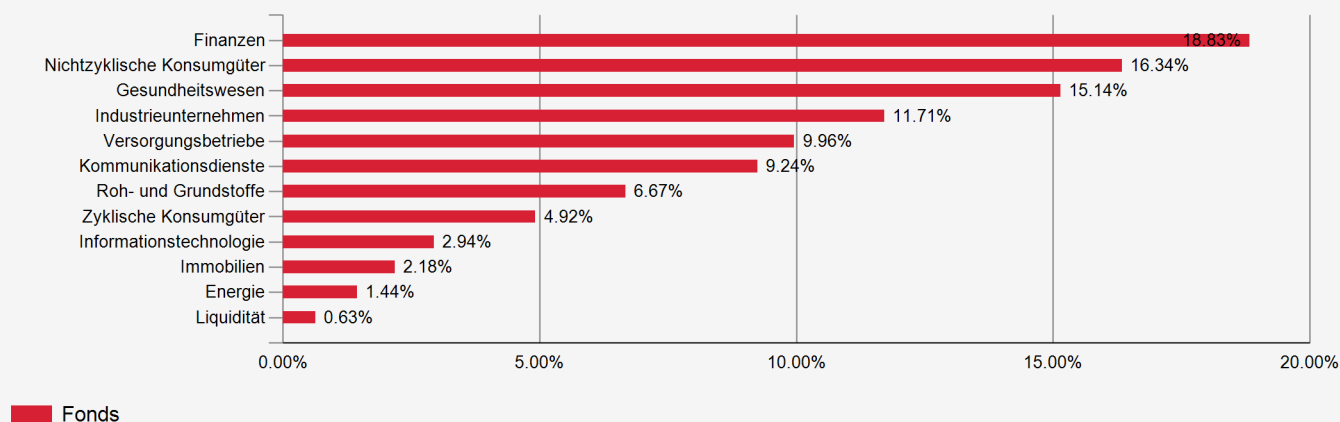
Swinging Single Pricing: Ja

Das Produkt beinhaltet ein Kapitalverlustrisiko.

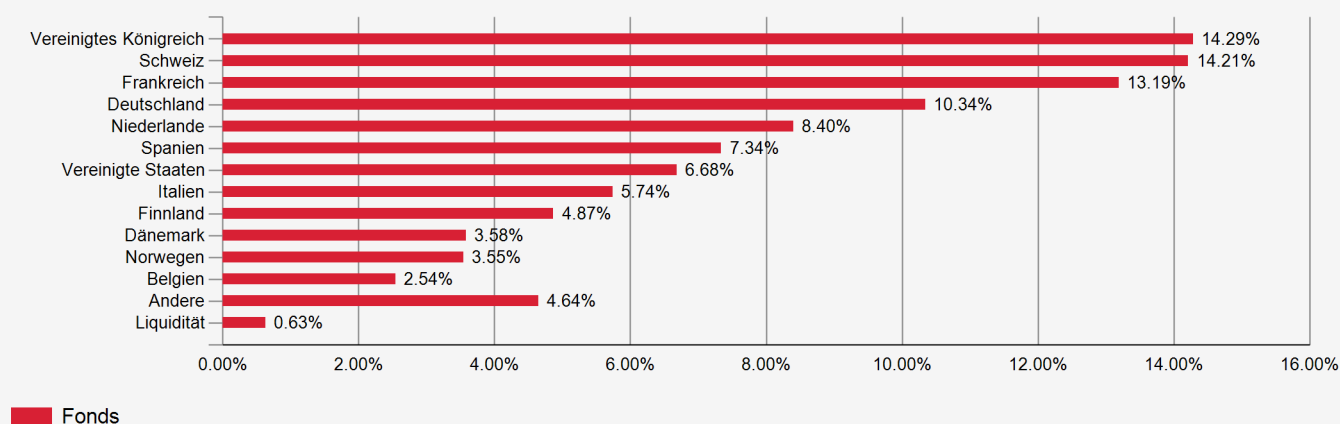
Swiss Life Funds (F) Equity ESG Europe

Minimum Volatility D

Aufteilung nach Sektoren



Geografische Aufteilung



Grösste Positionen

Nr.	Emittent	Länder	Sektoren	%
1	NOVARTIS AG-REG	Schweiz	Gesundheitswesen	2.03%
2	IBERDROLA SA	Spanien	Versorgungsbetriebe	1.99%
3	DANONE	Frankreich	Nichtzyklische Konsumgüter	1.92%
4	KONINKLIJKE KPN NV	Niederlande	Kommunikationsdienste	1.89%
5	SWISS PRIME SITE-REG	Schweiz	Immobilien	1.89%
6	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	Niederlande	Nichtzyklische Konsumgüter	1.86%
7	REDEIA CORP SA	Spanien	Versorgungsbetriebe	1.72%
8	WOLTERS KLUWER	Niederlande	Industrieunternehmen	1.72%
9	SAMPO OYJ-A SHS	Finnland	Finanzen	1.70%
10	UNILEVER PLC	Vereinigtes Königreich	Nichtzyklische Konsumgüter	1.64%
Total der grössten Positionen				18.34%
Anzahl Positionen				179